



AVIS AUX MEMBRES

N° 2004 - 005

Le 30 janvier 2004

OBLIGATIONS ADMISES EN DEPOTS DE COUVERTURE DES VENTES D'OPTIONS D'ACHAT

Options sur Obligations du Gouvernement du Canada

Vous trouverez ci-dessous la liste des Obligations du Gouvernement du Canada admissibles en dépôt de couverture des ventes d'options d'achat sur obligations.

La Règle A-708 (1) (b) s'interprète en partie comme suit:

"Les Obligations du Gouvernement du Canada qui:

- (i) constituent l'obligation sous-jacente; ou
- (ii) ont été jugées acceptables par la Corporation."(CDCC)

Ce sont les Obligations qui:

- (i) ont des coupons dont le taux est plus élevé;
- (ii) ont une valeur nominale à l'échéance d'au moins 1,000,000,000\$;
- (iii) se négocient à une prime de 5\$ supérieure à l'obligation sous-jacente, et
- (iv) arrivent à échéance au plus tôt 2 ans avant l'obligation sous-jacente.

<u>Obligations sous-jacentes</u>	<u>Obligations admises en couverture</u>
OBA- Gouvernement du Canada 5.25 % 01 juin 2012	10.50 % 15 mars 2021
	9.75 % 01 juin 2021
	8 % 01 juin 2023
	9 % 01 juin 2025
	8 % 01 juin 2027

Lara Krivokucha
Directeur Gestion des Risques

Corporation canadienne de compensation de produits dérivés

65, rue Queen Ouest
Bureau 700
Toronto, Ontario
M5H 2M5
Tél. : 416-367-2463
Télec. : 416-367-2473

800, square Victoria
3ième étage
Montréal (Québec)
H4Z 1A9
Tél. : 514-871-3545
Télec. : 514-871-3530

www.cdcc.ca